

# 海富通富满1号FOF集合资产管理计划

## 2024年第2季度报告

(报告期间：2024年04月01日至2024年06月30日)

### 一、投资管理人基本信息

表. 管理人基本信息

名称	海富通基金管理有限公司
地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室
法定代表人	杨仓兵
本组合投资经理	苏竞为

### 二、投资管理人及托管人履职报告

#### (一) 管理人履职情况

本报告期内，本计划资产管理人严格按照法律法规、资产管理合同的规定，独立管理和运用资产管理计划财产，自本合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划财产，配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产，建立健全内部控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的资产管理计划财产与本公司管理的基金财产、其他委托财产和资产管理人的财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，进行投资。未发现有为资产管理人及任何第三人谋取利益的情况。

#### (二) 托管人履职情况

本计划资产托管人设立了专门的资产托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉资产托管业务的专职人员，负责财产托管事宜。

本报告期内，本计划资产托管人按照法律法规及本计划资产管理合同的规定监督资产管理人的投资运作，安全保管资产管理计划财产，对所托管的不同资产管理计划财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立。除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，未发现有为资产托管人及任何第三人谋取利益的情况。

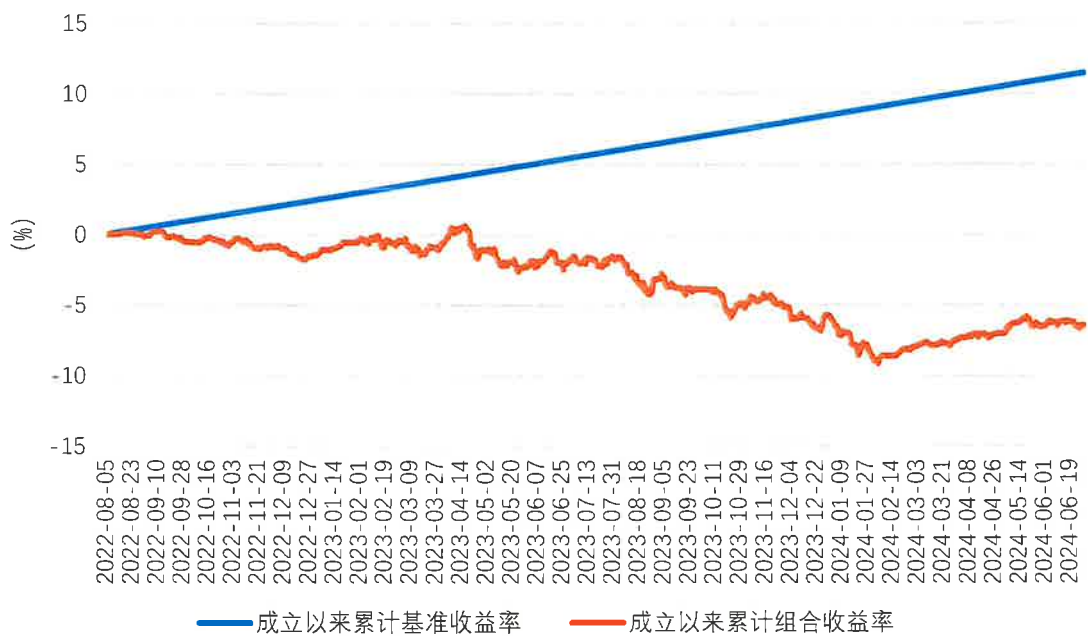
### 三、资产管理计划投资表现

#### (一) 投资组合表现

金额单位：人民币元

本组合初始委托资产	15,033,504.60
本期期初资产净值	3,423,787.29
本期期末资产净值	2,714,603.56
本期利润(收入-费用)	39,437.64
本期资产净值增长率	1.18%
自委托之日起资产净值增长率	-6.49%
本期期末单位净值(参考值)	0.9351

#### (二) 自委托之日起本组合资产净值增长率与业绩基准收益率走势比较图



时间区间：2022-08-05至2024-06-30

### 四、资产管理计划投资组合报告

#### (一) 投资资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	期末市值	市值占净值比
1	权益投资	0.00	0.00%
	其中：股票	0.00	0.00%
2	基金投资	2,640,473.58	97.27%

3	固定收益投资	0.00	0.00%
	其中：债券	0.00	0.00%
	资产支持证券	0.00	0.00%
4	金融衍生品投资	0.00	0.00%
5	买入返售金融资产	0.00	0.00%
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00%
6	银行存款和结算备付金合计	110,791.93	4.08%
7	其他资产	1,917.58	0.07%
	合计	2,753,183.09	101.42%

(二) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十大股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值	市值占净值比
-	-	-	-	-	-
合计			-	-	-

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十大债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	期末市值	市值占净值比
-	-	-	-	-	-
合计			-	-	-

## 五、资产管理计划运用杠杆情况（如有）

截至报告期末，组合时点杠杆率为101.42%，报告期间资产管理计划运用杠杆情况符合法律法规及合同约定。

## 六、基金中基金投资情况

### (一) 投资资产管理产品的选择标准

投资经理运用多维度的基金评价体系，结合定性调研和定量分析，优选基金产品。首先，通过定量分析基金经理的历史业绩和其管理产品的风险情况等定量指标筛选出符合条件的基金进入基金库，量化构建初级基金池。其次，通过对基金库中基金经理的调研，对基金经理的投资风格进行分类（权益基金经理可分为成长型、均衡型、价值型、激进型、灵活配置型、稳健型等；债券基金经理可分

为利率型、信用型、转债型、激进型、灵活性、稳健型等），进一步筛选投资能力突出的基金经理。根据资产配置方案和市场风格判断，并结合如公司投研团队、基金经理投资基因、基金规模、基金仓位等因素，建立判断矩阵。最后，通过对重点库中基金风格的持续跟踪，结合基金经理投资能力的分析，筛选出不同市场风格中投资能力均突出的基金经理所管理的基金产品，确定风格配置比例，确定目标投资基金。

(二) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金 资产净 值比例	是否属于基 金管理人及 管理人关联 方所管理的 基金
1	015832	永赢宏泰短 债 A	契约型开 放式	228,300.68	230,492.37	8.49%	否
2	009022	鹏华丰诚债 券 C	契约型开 放式	200,000.00	226,600.00	8.35%	否
3	006338	华安安浦债 券 C	契约型开 放式	230,000.00	226,527.00	8.34%	否
4	013449	广发景宁纯 债 C	契约型开 放式	191,521.09	219,636.39	8.09%	否
5	013380	景顺长城景 泰纯利债券 C	契约型开 放式	190,000.00	213,655.00	7.87%	否
6	019518	富国全球债 券(QDII)人 民币 C	契约型开 放式	156,867.87	203,865.48	7.51%	否
7	004998	长信全球债 券(QDII)人 民币份额	契约型开 放式	168,765.37	202,130.28	7.45%	否
8	518880	华安黄金易 (ETF)	契约型开 放式	35,200.00	186,454.40	6.87%	否
9	485007	工银添利债 券 B	契约型开 放式	120,000.00	156,516.00	5.77%	否
10	007361	易方达中短 期美元债 券 (QDII)C(人 民币份额)	契约型开 放式	91,506.63	101,535.76	3.74%	否

### （三）当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	159.88	0.00
当期交易基金产生的赎回费（元）	0.00	0.00
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	1,076.12	0.00
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	3,326.35	238.15
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	855.43	79.38
当期交易基金产生的交易费（元）	52.31	11.44
当期交易基金产生的转换费（元）	0.00	0.00

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本计划对被投资基金的实际持仓情况，根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。上述费用已在本计划所持有基金的净值中体现，不构成本计划的费用项目。

## 七、投资经理报告

### （一）本期市场与操作回顾（概述）

二季度A股市场高位震荡后下跌。沪深300指数下跌了2.14%、中证500指数下跌6.50%、科创50指数下跌6.64%、创业板综指下跌8.50%、中小综指下跌6.45%。分行业看，中信一级行业表现靠前的板块是银行、电力及公用事业、交通运输、煤炭、电子，跌幅较大的板块是消费者服务、传媒、商贸零售、计算机、轻工制造。当前市场风险偏好降低，类债策略依然是市场的主流预期，高股息率国企密集的行业更受到市场偏爱。

最新高频数据显示，多数房地产相关指标跌幅仍较大，在地产疲弱背景下国内经济预计仍以修复为主。从有关部门的发言来看，二季度整体经济继续稳中向好，全年有望实现5%左右的增长目标。在此背景下，预计总量刺激政策加码的可能性或降低，短期来看国内政策重心或将集中在供给侧而非需求端。

回顾过去一个季度，组合仓位保持在20-25%区间，持仓以红利、上游能源、黄金、海外QDII基金为主，获得了超越市场的相对表现。固收资产方面，组合以信用债基、海外QDII债基为底仓，同时也通过交易债券ETF增加组合的久期弹性。

## （二）下期市场展望与投资策略（概述）

展望三季度，我们倾向于认为三季度权益市场仍是结构性行情为主，因此组合仓位上不宜盲目追高，如市场回调出现机会则可以考虑增加仓位，持仓结构上依然以红利价值和海外QDII基金为主，后续关注市场风格变化进行调整。

固收方面，我们认为美国通胀数据有望向联储的目标靠近，且失业率的上升也会促使联储在9月份开启降息周期。我们将继续择机加仓海外QDII债券基金，以把握潜在的资本利得收益。国内债基部分，维持现有久期水平，注重分散投资和底层收益来源的多元化，后续跟踪市场变化，捕捉结构性券种机会。

## 八、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式的

费用类型	计提基准	计提方式和支付方式
管理费	前一日委托财产净值	每日计提，按季支付
托管费	前一日委托财产净值	每日计提，按季支付
业绩报酬	一个业绩报酬计算周期内委托财产净值增长超过基准净值增长的部分	资产委托人选择退出资产管理计划或资产管理计划终止财产清算完毕时收取

## 九、资产管理计划投资收益分配情况（如有）

无。

## 十、资产管理计划关联交易事项

### （一）重大关联交易情况

无。

### （二）一般关联交易情况

序号	日期	资管计划名称	证券代码	证券名称	交易方向	交易金额 (元)	交易价格
1	20240411	兴业银行富满1号FOF一对多	QDFA.501300	海富通美元债QDII人民币	买入	46,650.00	0.9330
2	20240412	兴业银行富满1号FOF一对多	QDFA.501300	海富通美元债QDII人民币	买入	46,250.01	0.9250

3	20240426	兴业银行富满1号 FOF 一对多	511360	短融 ETF	卖出	54,815.80	109.6316
4	20240429	兴业银行富满1号 FOF 一对多	511360	短融 ETF	卖出	76,720.00	109.6000
5	20240507	兴业银行富满1号 FOF 一对多	511360	短融 ETF	卖出	87,736.00	109.6700
6	20240607	兴业银行富满1号 FOF 一对多	QDFA.501300	海富通美元债 QDII 人民币	卖出	28,470.00	0.9490
7	20240611	兴业银行富满1号 FOF 一对多	QDFA.501300	海富通美元债 QDII 人民币	卖出	28,620.00	0.9540
8	20240612	兴业银行富满1号 FOF 一对多	QDFA.501300	海富通美元债 QDII 人民币	卖出	38,080.00	0.9520
9	20240614	兴业银行富满1号 FOF 一对多	QDFA.501300	海富通美元债 QDII 人民币	卖出	48,500.00	0.9700
10	20240624	兴业银行富满1号 FOF 一对多	QDFA.501300	海富通美元债 QDII 人民币	卖出	49,600.00	0.9920

## 十一、投资经理变更等涉及投资者权益的重大事项

### （一）投资经理变更情况

无。

### （二）报告期内重大事项

无。

报告期内，海富通对本组合的各项监督指标进行了持续监控，总体而言，执行情况良好，未发生任何主动违反投资政策的情况。

## 十二、管理人及其关联方投资情况

本计划管理人从业人员认购了本计划份额，相关账户持有份额及占比情况如下：

持有人	持有份额总数	持有份额占计划总份额比例
管理人从业人员	413,052.46	14.23%
合计	413,052.46	14.23%

## 十三、公平交易专项说明

公司根据证监会2011年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见

见》的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场、二级市场的所有投资交易管理活动及公司内部的证券分配，涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度，公司投资交易行为监控体系由交易部、投资部门、督察稽核部和风险管理部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，未发现本组合进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 十四、其他需要说明的情况

（一）本期报表数据是否经与托管人复核  
是。

（二）中国证监会规定的其他事项  
无。

#### 十五、声明

本公司郑重承诺报告所提供的内容、数据、报表、附件真实、准确、完整。

海富通基金管理有限公司

2024年7月19日

